华宝兴业增强收益债券型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业增强收益债券	
基金主代码	240012	
交易代码	240012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年2月17日	
报告期末基金份额总额	33,964,544.25份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,追求较高的当期收益和总回报,争取实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别(包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等)的预期收益进行动态跟踪,决定其配置比例。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金和股票型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险程度和预期收益率高于纯债券基金。	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
下属两级基金的交易代码	240012	240013
报告期末下属两级基金的份额总额	18,717,793.20份	15,246,751.05份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)	
	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
1.本期已实现收益	424,347.40	319,516.28
2.本期利润	821,475.92	668,375.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0427	0.0413
4.期末基金资产净值	21,637,441.26	17,247,845.28
5.期末基金份额净值	1.1560	1.1312

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业增强收益债券A

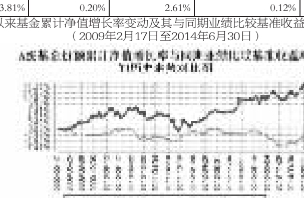
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.92%	0.20%	2.61%	0.12%	1.31%	0.08%

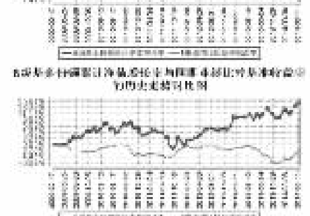
华宝兴业增强收益债券B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.81%	0.20%	2.61%	0.12%	1.20%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2009年2月17日至2014年6月30日)





注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2009年8月16日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王瑞海	固定收益部总经理、本基金基金经理、华宝兴业活期通货币基金经理、华宝兴业可转债债券基金经理	2013年4月8日	-	19年	硕士。曾在深圳中大投资管理公司、海南证券北京营业部、太平人寿保险有限公司、太平资产管理有限公司从事投资管理、股票自营和固定收益投资研究工作。2012年7月加入华宝兴业基金管理有限公司,任固定收益部总经理。2013年4月起兼任华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金经理,2014年2月至2014年5月任华宝兴业中证短融50指数债券型证券投资基金基金经理,2014年5月起兼任华宝兴业活期通货币市场基金(由短融50基金转型)基金经理,2014年5月兼任华宝兴业可转债债券型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,前两个月的收益率水平一直处于下降的过程中,进入六月份以后,由于市场担心六月末的资金面,下降的速度有所减缓。以实际的全价价格涨幅衡量,城投债为代表的信用品种表现好于国开债为代表的利率品种。信用利差总体处于缩小的过程中。

二季度的前期,维持较高的杠杆比例,收益表现良好。进入六月,降低杠杆比例,规避六月底的冲击。组合分为两个部分,一是长久期的利率债,另一部分是短久期的信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内增强收益A基金份额净值增长率为3.92%,同期业绩比较基准收益率为2.61%;增强收益B基金份额净值增长率为3.81%,同期业绩比较基准收益率为2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

五月中旬以来资金持续宽松,央行公开市场操作较为灵活,从六月份开始始终是净投放。 在稳增长的大环境下,央行会呵护货币市场,这从多次定向降准可以看出。 五月份财政存款增量低于预期,稳增长背景下加大财政支出力度是主要原因,未来这也是资金宽松的原因之一。整体上来说,资本市场波动幅度会下降。

由于大的投资环境比较宽松,市场的风险偏好会逐渐上升。但不赞成在信用品种上做过多关注,因为从监管层对信用问题的模糊处理来看,信用紧缩的风险仍在。仍然将会加大杠杆,主攻利率品种,并拉长久期。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,673,340.00	5.63
	其中:股票	2,673,340.00	5.63
2	固定收益投资	42,600,032.20	89.66
	其中:债券	42,600,032.20	89.66
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	257,494.47	0.54
7	其他资产	1,981,773.94	4.17
8	合计	47,512,640.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,182,080.00	5.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	491,260.00	1.26
S	综合	-	-
	合计	2,673,340.00	6.87

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300199	翰宇药业	34,000	829,260.00	2.13
2	300216	千山药机	30,000	750,900.00	1.93
3	300003	乐普医疗	28,800	601,920.00	1.55
4	300291	华录百纳	14,000	491,260.00	1.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,651,984.10	47.97
	其中:政策性金融债	18,651,984.10	47.97
4	企业债券	18,684,405.90	48.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	5,263,642.20	13.54
8	其他	-	-
9	合计	42,600,032.20	109.55

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140203	14国开03	100,000	10,462,000.00	26.90
2	018002	国开1302	45,020	4,730,701.60	12.17
3	122040	09新黄浦	36,000	3,614,400.00	9.30
4	122044	10连云债	35,500	3,571,300.00	9.18
5	122036	09沪张江	35,500	3,563,135.00	9.16

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,936.81
2	应收证券清算款	898,931.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,041,654.14
5	应收申购款	28,251.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,981,773.94

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	1,221,480.00	3.14
2	113005	平安转债	1,175,020.00	3.02
3	110020	南山转债	1,045,440.00	2.69
4	110023	民生转债	881,600.00	2.27
5	127002	徐工转债	469,815.00	1.21
6	110017	中海转债	468,200.00	1.20
7	110018	国电转债	2,087.20	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300199	翰宇药业	829,260.00	2.13	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华宝兴业增强收益债券A	华宝兴业增强收益债券B
报告期期初基金份额总额	20,574,658.71	17,053,309.38
报告期期间基金总申购份额	4,062,430.74	1,745,984.10
减:报告期期间基金总赎回份额	5,919,296.25	3,552,542.43
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	18,717,793.20	15,246,751.05

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	150,095.36
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	150,095.36
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.44

注:其中基金管理人持有华宝增强债A的份额为86,597.54份,持有华宝增强债B的份额为63,497.82份。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金资产规模低于5000万,对于基金的投资运作管理带来一定影响,敬请投资者注意风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金基金合同;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业增强收益债券型证券投资基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

华宝兴业中证100指数证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业中证100指数
基金主代码	240014
交易代码	240014
前端交易代码	240014
后端交易代码	240015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年9月29日
报告期末基金份额总额	630,395,867.78份
投资目标	本基金通过指数化投资,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证100指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,013,122.87
2.本期利润	7,059,619.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	403,803,558.32
5.期末基金份额净值	0.6406

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

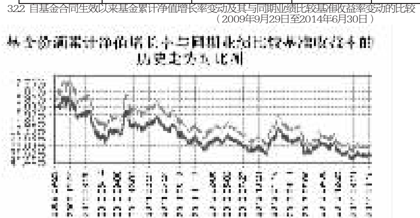
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.81%	0.86%	0.77%	0.86%	1.04%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2009年9月29日至2014年6月30日)



注:基金依法应自成立日期起6 个月内达到基金合同约定的资产组合,截至2009年11月6日,本基金已完成建仓且达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐林明	助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业上证180价值ETF基金经理、华宝兴业上证180价值ETF联接基金基金经理、量化投资部总经理	2009年9月29日	-	12年	复旦大学经济学硕士,FRM,曾在兴业证券、凯龙财经(上海)有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009年9月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理,2010年2月起任量化投资部总经理,2010年4月起兼任华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证180价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2014年6月任助理投资总监。
陈建华	本基金基金经理	2012年12月22日	-	13年	硕士。曾在南方证券上海分公司工作。2007年8月加入华宝兴业基金管理有限公司,先后在研究部、量化投资部任助理分析师、数量分析师、华宝兴业上证180价值ETF、华宝兴业上证180价值ETF联接基金经理助理,兼任华宝兴业上证180成长ETF、华宝兴业上证180成长ETF联接基金经理助理,2012年12月起任华宝兴业中证100指数型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业中证100指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2014年二季度,宏观经济延续一季度的经济形势继续缓慢下滑。为确保经济增长达到7.5%,在5月下旬政策出现明显转变信号,央行第二次定向降准,部分城市房地产政策出现松动迹象,铁路等重点项目的投资建设等,使市场预期得到了稳定。因为经济总体不乐观,沪深A股主板市场整体维持着低位窄幅震荡走势,而创业板大幅波动,板块结构表现分化严重。在本报告期中,沪深300和中证100指数分别上涨0.79%和0.88%,而创业板和中小板指数上涨分别为5.79%和4.35%。

本报告期本基金为正常运作期,在操作中,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.6406元,本报告期份额净值增长率为1.81%,同期业绩比较基准增长率为0.77%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.03%,年化跟踪误差为0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年三季度,稳增长措施将继续对冲经济下行的风险,发行节奏控制和申购规则修改后的新股发行对市场的压力将逐步回归正常,而资金面方面预计将维持二季度相对宽松的局面。今年以来的经济指标和大类资产表现呈现了典型的经济衰退期特征,随着利率水平的下降,股市的相对吸引力在提高,尤其对于估值处于历史底部区域的蓝筹股。建议投资者根据宏观经济和流动性情况把握中证100指数基金的投资机会。

作为指数基金的管理人,我们将继续严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,积极应对成分股调整和基金申赎变动,严格控制基金相对目标指数的跟踪误差,实现对中证100指数的有效跟踪。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	383,154,689.78	94.37
	其中:股票	383,154,689.78	94.37
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	22,609,954.89	5.57
7	其他资产	269,939.75	0.07
8	合计	406,034,584.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	21,651,873.46	5.36
C	制造业	113,975,027.18	28.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,152,216.34	3.01
E	建筑业	13,427,083.16	3.33
F	批发和零售业	3,472,083.36	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	8,618,426.07	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,225,280.45	1.54
J	金融业	183,433,821.75	45.43
K	房地产业	15,505,728.98	3.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,038,213.03	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,631,096.00	0.65
	合计	383,130,849.78	94.88

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	23,840.00	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,840.00	0.01

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	3,635,691	22,577,641.11	5.59
2	601318	中国平安	573,068	22,544,495.12	5.58
3	600036	招商银行	1,969,000	20,162,560.00	4.99
4	601166	兴业银行	1,363,900	13,679,917.00	3.39
5	600000	浦发银行	1,335,300	12,084,465.00	2.99
6	600030	中信证券	938,068	10,750,259.28	2.66
7	000002	万 科A	1,157,654	9,573,798.58	2.37
8	000651	格力电器	307,939	9,068,803.55	2.25
9	600837	海通证券	968,136	8,858,444.40	2.19
10	601288	农业银行	3,103,613	7,821,104.76	1.94

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.00
2	002726	龙大肉食	500	8,530.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2013年10月14日中国平安公告其控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号)。中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

2013年9月25日中国民生银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是江苏汇鸿国际集团有限公司作为相关债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,未合规披露子公司中融信托对外担保信息。主承销商中信银行、民生银行、广发银行在尽职调查中未将中融信托对外担保情况作为或有事项进行专项了解,亦未辅导企业在募集说明书中披露上述情况。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、民生银行、广发银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

2013年11月13日招商银行股份有限公司收到交易商协会自律处分。处罚原因是林州重机集团股份有限公司作为债务融资工具发行人,在债务融资工具存续期间,因减资事项涉及重大事项信息披露延迟及持有人会议延迟召开等情形。主承销商招商银行、中信银行在后续管理工作中未充分尽职履责。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予主承销商中信银行、招商银行诫勉谈话处分,并处责令改正。

2013年9月25日中国农业银行股份有限公司因其作为债务融资工具主承销商,近期涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规范要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形,根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予农业银行通报批评处分,并处责令改正。

本基金为开放式指数基金,采用完全复制法进行指数化投资,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

本报告期内,本基金投资的前十名证券的其余六名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,542.52
2	应收证券清算款	198,970.57
3	应收股利	-
4	应收利息	4,572.97
5	应收申购款	7,853.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	269,939.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603328	依顿电子	15,310.00	0.00	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	630,195,912.80
报告期期间基金总申购份额	27,002,906.60
减:报告期期间基金总赎回份额	26,802,951.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	630,395,867.78

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	4,902,136.78
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,902,136.78
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.78

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业中证100指数证券投资基金基金合同;

华宝兴业中证100指数证券投资基金招募说明书;

华宝兴业中证100指数证券投资基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华宝兴业资源优选
基金主代码	240022
交易代码	240022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月21日
报告期末基金份额总额	96,889,522.71份
投资目标	把握资源相关行业的投资机会,力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对资源相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值,分享资源稀缺性所带来的行业高回报。本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期,结合自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。本基金将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况,将部分资产投资于中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,包括但不限于可转换债券、央行票据,以捕捉市场机会,提高基金资产的使用效率。
业绩比较基准	80%×中证内地资源主题指数收益率+20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	187,010.24
2.本期利润	744,739.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0077
4.期末基金资产净值	68,436,592.67
5.期末基金份额净值	0.706

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	1.02%	1.71%	0.90%	-0.27%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2012年8月21日至2014年6月30日)

注:按照基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截至2013年2月21日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡目荣	本基金基金经理	2012年8月21日	-	11年	硕士。曾在金信研究、国金证券股份有限公司从事研究工作,2008年6月进入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任高级分析师、研究部总经理助理、基金经理助理和交易员的职务。2012年8月起任华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在政府陆续出台微刺激措施情况下,2014年二季度国内经济形势依然低迷,固定资产投资(尤其是房地产投资)、社会消费品零售总额等数据都比较低迷,工业利润增长放缓。经济低迷一方面是国内经济结构调整的结果,同时也受环保、反腐等多重因素影响。从国内市场流动性角度看,虽然6月底由于新股申购导致市场资金一度紧张,但二季度整体还是维持了宽松局面。由于私人消费及出口贡献向下修正,美国一季度GDP终值大幅下调,但近期高频数据和领先指标显示美国经济自3月份以来环比缓慢回升;欧洲、日本经济继续改善,目前看乌克兰局势没有对欧洲经济造成太大冲击。

A股市场二季度呈现震荡略微上涨走势,主板指数振幅较小,创业板指数波动偏大。

二季度市场波动主要是受沪港通、定向降准、IPO重启、创业板再融资放开等消息刺激,但由于经济表现疲弱,市场整体走势一般。二季度上证指数涨幅0.74%,深成指涨幅2.14%,创业板指数涨幅5.79%,内地资源指数涨幅1.80%,中信煤炭指数跌幅3.01%,中信有色指数跌幅6.34%。

二季度资源板块略好于主板指数表现,但整体走势还是弱于创业板股票。由于本基金在有色板块方面配置略有不足,报告期内本基金略微跑输了行业基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为1.44%,同期业绩比较基准收益率为1.71%,基金表现落后业绩基准0.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年三季度,国内中央及地方政府纷纷加码稳增长政策,甚至采取放松地产限购等政策,国内经济有望逐步企稳回升。从先行指标(如PMI指数)看,国内经济有企稳迹象。从国外看,预计美国和欧洲继续维持缓慢复苏,不确定性可能来自中东及乌克兰局势变化,目前看风险不大。

对于A股市场来说,主板和创业板经历了近两年持续分化,大小股票估值已经出现了明显背离。在市场对国内经济未来预期依然较为悲观以及经济转型预期下,大股票出现逆转暂时还不具备条件,但由于被低谷,局部性投资机会将会不断涌现。对资源板块来说,由于近两年来跌幅较大,很多个股已经跌出了价值,虽然大的环境还不支持板块整体出现机会,但预计局部性机会将会不断出现。未来本基金配置上主要偏向于投资资源行业里面景气处于底部,未来有望复苏的子行业;同时重点关注未来有望受益于新经济发展方向的自然资源、受益于环保监管加强带来供给约束的资源类子行业。三季度我们将努力寻找自然资源领域新的投资机会,为投资人创造好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	57,823,110.50	83.59
	其中:股票	57,823,110.50	83.59
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	6,000,000.00	8.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,230,143.78	6.12
7	其他资产	1,118,056.95	1.62
8	合计	69,171,311.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,050,700.00	1.54
B	采矿业	36,019,602.30	52.63
C	制造业	13,120,224.20	19.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,688,300.00	5.39
F	批发和零售业	493,324.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,180,200.00	1.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	515,760.00	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,755,000.00	2.56
	合计	57,823,110.50	84.49

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	400,000	5,816,000.00	8.50
2	600028	中国石化	1,087,500	5,731,125.00	8.37
3	601699	潞安环能	343,600	2,607,924.00	3.81
4	600123	兰花科创	320,000	2,406,400.00	3.52
5	000937	冀中能源	410,000	2,390,300.00	3.49
6	600549	厦门钨业	93,323	2,370,404.20	3.46
7	601898	中煤能源	500,860	2,018,465.80	2.95
8	601857	中国石油	260,000	1,960,400.00	2.86
9	002155	辰州矿业	254,400	1,902,912.00	2.78
10	600348	阳泉煤业	335,000	1,889,400.00	2.76

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

2014 年1 月13 日中国石化发布公告:国务院对山东省青岛市"11?22"中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查处理报告已作出批复,同意国务院事故调查组的调查处理结果,对中国石化及当地政府的48名责任人分别给予纪律处分,对涉嫌犯罪的15名责任人移送司法机关依法追究法律责任。根据国务院事故调查组的统计,本次事故造成直接经济损失人民币75,172万元,公司将承担其相应赔偿责任。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和分析,认为该处罚不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,628.18
2	应收证券清算款	1,093,075.99
3	应收股利	-
4	应收利息	9,403.96
5	应收申购款	3,948.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,118,056.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	95,633,149.17
报告期期间基金总申购份额	13,436,456.59
减:报告期期间基金总赎回份额	12,180,083.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	96,889,522.71

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	422,523.24
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	422,523.24
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.44

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金基金合同;

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金招募说明书;

华宝兴业资源优选股票型证券投资基金托管协议;

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;

基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日